

DAFTAR ISI

SURAT PERNYATAAN KARYA SENDIRI **i**

LEMBAR PENGESAHAN SKRIPSI..... **ii**

ABSTRAK..... **iii**

BAB I PENDAHULUAN

A. Latar Belakang Penelitian.....	1
B. Rumusan Masalah Penelitian.....	10
C. Tujuan dan Kontribusi Penelitian	
1. Tujuan Penelitian.....	10
2. Kontribusi Penelitian	11

BAB II KAJIAN PUSTAKA, KERANGKA KONSEPTUAL DAN PENGEMBANGAN HIPOTESIS

A. Kajian Pustaka

1. Pengertian Pasar modal.....	12
2. Pengertian Saham	12
3. Macam-macam Jenis Saham.....	13
4. Macam-macam Analisis Saham.....	16
5. Pengertian Harga Saham.....	16
6. Faktor-faktor yang Mempengaruhi Saham	18
7. Return On Equity (ROE)	
a. Pengertian Return On Equity (ROE)	20
b. Pengukuran Return On Equity (ROE)	22
8. Net Profit Margin (NPM)	
a. Pengetian Net Profit Margin (NPM).....	22
b. Pengukuran Net Profit Margin (NPM)	23
9. Earning Per Share (EPS)	
a. Pengertian Earning Per Share (EPS).....	23
b. Pengukuran Earning Per Share (EPS).....	24
10. Penelitian Terdahulu.....	25

B. Kerangka Konseptual	29
C. Tinjauan Hipotesis	30
BAB III METODE PENELITIAN	
A. Waktu dan Tempat Penelitian	34
B. Desain Penelitian	34
C. Definisi dan Operasional Variabel.....	35
1. Definisi Return On Equity	36
2. Definisi Net Profit Margin (NPM)	36
3. Definisi Earning Per Share (EPS)	37
4. Definisi Harga Saham.....	37
D. Pengukuran Variabel	38
E. Populasi dan Sampel Penelitian	
1. Populasi Penelitian	39
2. Sampel Penelitian	40
F. Teknik Pengumpulan Data	41
G. Metode Analisis	
1. Analisis Deskriptif	41
2. Analisa Kualitas Data	
a. Uji Stasioneritas.....	41
3. Analisis Regresi Linear Data Panel	43
4. Model Regresi Data Panel	
a. Common Effect Model	46
b. Fixxed Effect Model	46
c. Random Effect Model.....	47
5. Pemilihan Model Regresi Data Panel	
a. Uji F (test) chow	48
b. Uji Hausman (test).....	50
c. Uji Langrange Multiple	51
6. Uji Model Regresi Data Panel	
a. Koefisien Determinasi (R^2).....	52
b. Model Anova (Uji F)	53
c. Uji Koefisien Regresi Data Panel.....	55

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

A. Gambaran Umum Objek Penelitian	
1. Tempat dan Waktu Penelitian	57
2. Karakteristik Profil Perusahaan	57
B. Hasil Uji Stastistik Deskriptif	63
C. Hasil Uji Analisis Kelayakan Data	
1. Uji Stasioner Harga Saham.....	67
2. Uji Stasioner <i>Return On Equity</i> (ROE)	68
3. Uji Stasioner <i>Net Profit Margin</i> (NPM)	69
4. Uji Stasioner <i>Earning Per Share</i> (EPS)	71
D. Analisis Regresi Data Panel	
1. Model Data Panel	
a. <i>Common Effect Model</i>	72
b. <i>Fixed Effect Model</i>	74
c. <i>Random Effect Model</i>	76
2. Pemilihan Model Regresi Data Panel	
a. Uji <i>Chow</i>	78
b. Uji <i>Hausman</i>	79
c. Uji <i>Lagrange Multiplier</i>	80
3. Analisis Model Regresi Data Panel.....	81
4. Uji Kelayakan Model Regresi Data Panel	
a. Koefisiensi Determinasi.....	81
b. Uji F.....	82
E. Analisis Koefisien Data Panel	
a. Pengaruh <i>Net Profit Margin</i> Terhadap Harga Saham	83
b. Pengaruh <i>Return On Equity</i> Terhadap Harga Saham.....	85
c. Pengaruh <i>Earning Per Share</i> Terhadap Harga Saham.....	87
F. Pembahasan Hasil Penelitian.....	88

BAB V SIMPULAN DAN SARAN

A. Simpulan	90
B. Saran	91

